



LDB
EMPRESAS

HORTOLÂNDIA
FEVEREIRO 2022



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 25.02.2022.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

79,15%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,69	1,08	1,06	35.387.823,14	5,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,50	0,17	-1,29	14.899.829,26	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,170000%)	2,75	1,08	2,18	20.311.189,05	3,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,660001%)	3,96	0,74	0,74	20.143.235,84	3,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,020001%)	2,64	1,07	2,16	47.543.709,22	7,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,92	0,98	1,41	138.285.786,51	21,33

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,70	0,74	1,36	52.461.509,81	8,09	5.025.689.167,39	1,04
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,63	0,53	-0,24	71.149.297,13	10,97	6.297.272.158,07	1,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	82.623.812,18	12,74	10.680.932.817,60	0,77
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,15	0,93	1,46	50.011.662,86	7,71	2.413.852.979,92	2,07
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	48.598.224,03	7,50	6.887.287.977,51	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	62.003.215,71	9,56	10.665.837.627,38	0,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,55	0,82	0,93	366.847.721,72	56,58		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
QUELUZ	ORLA	BRA1 FI RENDA FIXA	1,47	0,62	0,43	398.920,88	0,06	9.564.611,38	4,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VERITAS	RJI	FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	47,68	-15,62	-15,91	508.162,13	0,08	77.475.972,66	0,66
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,41	0,20	1,09	3.633.303,42	0,56	68.842.798,18	5,28
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			5,15	-1,82	-1,20	4.540.386,43	0,70		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,13	0,37	0,87	1.836.722,63	0,28	72.717.540,56	2,53
FINAXIS	FINAXIS	FIDC PREMIUM	3,53	-0,16	-0,33	1.662.148,95	0,26	81.898.860,94	2,03
BRPP	BRPP	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRPP	GENIAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			0,69	0,11	0,29	3.498.871,58	0,54		
Renda Fixa			2,47	0,83	1,03	513.172.766,24	79,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

14,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	22,76	-1,44	2,47	24.550.279,52	3,79	1.330.917.641,81	1,84
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,37	-1,47	1,13	46.384.408,47	7,15	1.428.707.503,72	3,25
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,41	-1,21	0,11	25.905.500,92	4,00	2.516.394.706,99	1,03
Sub-total Artigo 8º I			18,73	-1,39	1,19	96.840.188,91	14,94		
Renda Variável			16,62	-1,39	1,19	96.840.188,91	14,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,06%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,84	-9,75	-25,87	10.470.992,34	1,62	923.354.073,39	1,13
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	18,04	-5,52	-16,04	22.334.633,95	3,44	314.493.098,59	7,10
Sub-total Artigo 9º II			19,06	-6,91	-19,45	32.805.626,29	5,06		
Investimentos no Exterior			19,06	-6,91	-19,45	32.805.626,29	5,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,35%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
GRAPHEN	ORLA	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,70	-1,10	-1,52	215.867,90	0,03	1.528.776,71	14,12
Sub-total Artigo 10º I			0,70	-1,10	-1,52	215.867,90	0,03		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRPP	BNY MELLON	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	92,58	-0,36	-0,68	525.771,70	0,08	19.312.944,98	2,72
VALORA	BEM	FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	84,22	6,94	15,85	-276,97	-0,00	-59.767,29	
QUELUZ	BNY MELLON	BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	0,34	-0,05	-0,11	1.509.406,31	0,23	27.882.719,06	5,41
Sub-total Artigo 10º II			0,45	-0,13	-0,26	2.034.901,04	0,31		
Investimentos Estruturados			0,44	-0,22	-0,38	2.250.768,94	0,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,50%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	12,17	-3,95	-6,41	1.884.000,00	0,29	1.322.246.699,64	0,14
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRCR11	20,19	-2,46	-3,97	223.454,64	0,03	2.861.919.636,26	0,01
AQUILLA	ÍNDIGO	ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	52,38	-0,93	-1,80	1.163.477,74	0,18	92.887.389,62	1,25
Sub-total Artigo 11º			10,81	-2,79	-4,65	3.270.932,38	0,50		
Fundos Imobiliários			10,81	-2,79	-4,65	3.270.932,38	0,50		
Total			3,95	0,06	-0,26	648.340.282,76	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	138.285.786,51	21,33	0,00	27,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	366.847.721,72	56,58	0,00	35,50	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	4.540.386,43	0,70	0,00	1,00	65,00	0,00	65,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	3.498.871,58	0,54	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	513.172.766,24	79,15					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	96.840.188,91	14,94	0,00	18,00	35,00	0,00	35,00
	Total Renda Variável	96.840.188,91	14,94					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	32.805.626,29	5,06	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	32.805.626,29	5,06					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	215.867,90	0,03	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	2.034.901,04	0,31	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	2.250.768,94	0,35					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.270.932,38	0,50	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	3.270.932,38	0,50					5,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,98 130,51	1,41 94,81	2,19 96,84	4,41 115,65	6,55 116,00	1.282.692,00	1.790.742,68
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,82 109,20	0,93 62,83	1,61 71,22	2,62 68,75	3,05 53,95	3.067.855,01	3.531.264,73
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-1,82 -243,25	-1,20 -80,93				-84.324,84	-55.320,98
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	0,11 15,18	0,29 19,76				3.976,13	10.254,39
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,39 -2,28	1,19 -6,75				-1.369.330,72	1.137.757,19
Artigo 9º II % do CDI	-6,91 -922,03	-19,45 -1.307,80	-19,61 -867,02	-14,94 -392,14	-13,31 -235,74	-2.435.647,94	-7.922.135,30
Artigo 10º I % do CDI	-1,10 -147,17	-1,52 -102,48				-2.407,87	-3.341,33
Artigo 10º II % do CDI	-0,13 -17,31	-0,26 -17,29				-2.644,48	-5.247,57
Artigo 11º % do CDI	-2,79 -372,86	-4,65 -312,94				-93.929,77	-159.833,10
HORTOLÂNDIA (Total)						366.237,52	-1.675.859,29

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,170000%)	20.094.350,80	0,00	0,00	0,00	20.311.189,05	216.838,25	433.903,75
NTN-B 150545	14.874.046,60	0,00	0,00	0,00	14.899.829,26	25.782,66	-194.343,84
NTN-B 150545 (5,660001%)	0,00	19.996.116,03	0,00	0,00	20.143.235,84	147.119,81	147.119,81
NTN-B 150824	36.036.566,67	0,00	0,00	1.033.096,58	35.387.823,14	384.353,05	379.545,90
NTN-B 150840 (5,020001%)	48.286.430,92	0,00	0,00	1.251.319,93	47.543.709,22	508.598,23	1.024.517,06
					138.285.786,51	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	48.300.685,82	0,00	0,00	0,00	48.598.224,03	297.538,21	315.879,67
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	70.771.678,95	0,00	0,00	0,00	71.149.297,13	377.618,18	-170.033,95
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	47.373.679,57	9.247.900,00	-4.540.000,00	0,00	52.461.509,81	379.930,24	688.146,11
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	101.566.738,97	0,00	-20.000.000,00	0,00	82.623.812,18	1.057.073,21	1.076.177,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.507.621,68	0,00	0,00	0,00	62.003.215,71	495.594,03	903.499,82
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	49.551.561,72	0,00	0,00	0,00	50.011.662,86	460.101,14	717.595,88
					366.847.721,72	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRA1 FI RENDA FIXA	396.466,97	0,00	0,00	0,00	398.920,88	2.453,91	1.692,61
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	602.222,88	0,00	0,00	0,00	508.162,13	-94.060,75	-96.139,44
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.626.021,42	0,00	0,00	0,00	3.633.303,42	7.282,00	39.125,85
					4.540.386,43	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIDC PREMIUM	1.664.887,35	0,00	0,00	0,00	1.662.148,95	-2.738,40	-5.536,20
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.830.008,10	0,00	0,00	0,00	1.836.722,63	6.714,53	15.790,59
					3.498.871,58	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	47.078.090,50	0,00	0,00	0,00	46.384.408,47	-693.682,03	516.911,63
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	24.908.180,97	0,00	0,00	0,00	24.550.279,52	-357.901,45	591.375,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	26.223.248,16	0,00	0,00	0,00	25.905.500,92	-317.747,24	29.469,87
					96.840.188,91	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11.602.621,07	0,00	0,00	0,00	10.470.992,34	-1.131.628,73	-3.654.577,30
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23.638.653,16	0,00	0,00	0,00	22.334.633,95	-1.304.019,21	-4.267.558,00
					32.805.626,29	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	218.275,77	0,00	0,00	0,00	215.867,90	-2.407,87	-3.341,33
					215.867,90	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	1.510.111,66	0,00	0,00	0,00	1.509.406,31	-705,35	-1.619,72
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	-258,99	0,00	0,00	0,00	-276,97	-17,98	-37,90
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	527.692,85	0,00	0,00	0,00	525.771,70	-1.921,15	-3.589,95
					2.034.901,04	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRCR11	230.693,22	0,00	0,00	0,00	1.623,00	223.454,64	-5.615,58	-9.251,10
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	1.979.800,00	0,00	0,00	0,00	18.400,00	1.884.000,00	-77.400,00	-129.200,00
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	1.174.391,93	0,00	0,00	0,00	0,00	1.163.477,74	-10.914,19	-21.382,00
						3.270.932,38	0,00	0,00

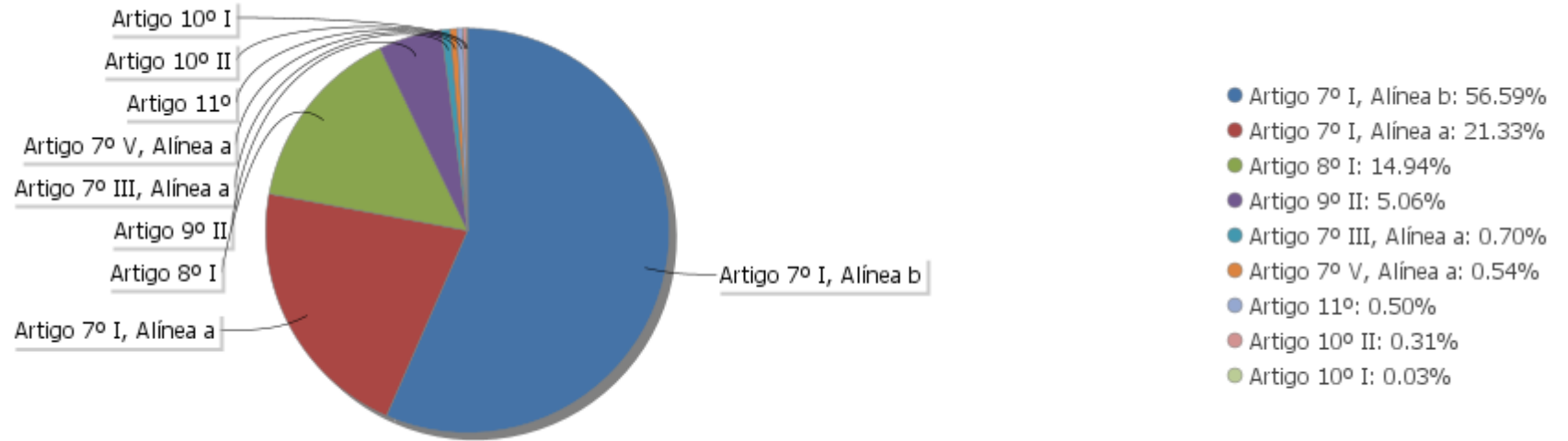
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

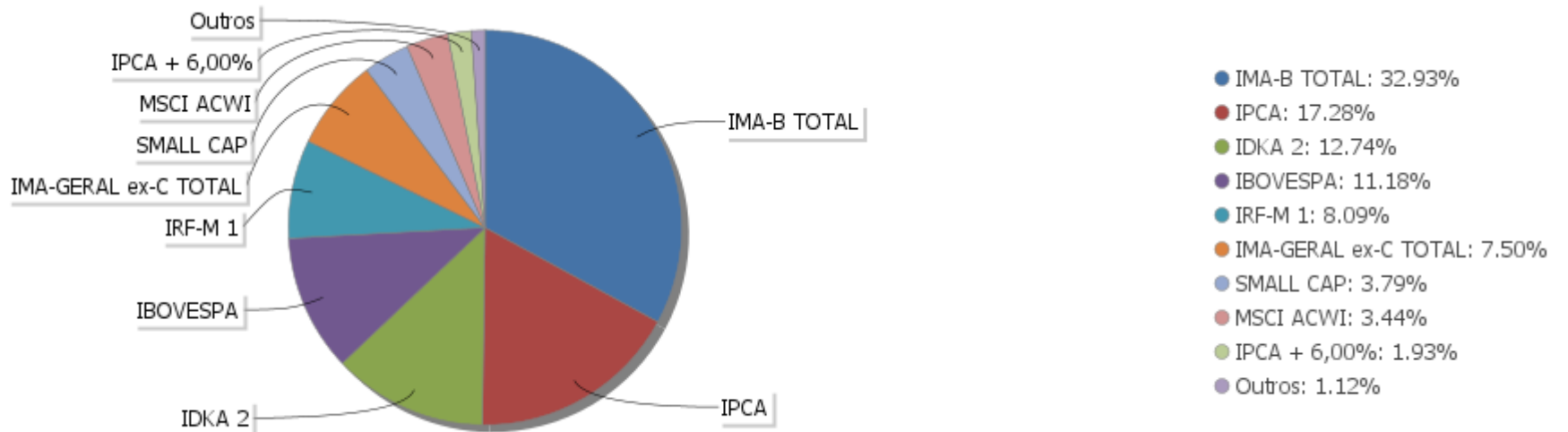
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	476.561.131,16	73,50	476.561.131,16	73,50
de 31 a 365 dias	25.905.500,92	4,00	502.466.632,08	77,50
acima de 365 dias	145.873.650,68	22,50	648.340.282,76	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

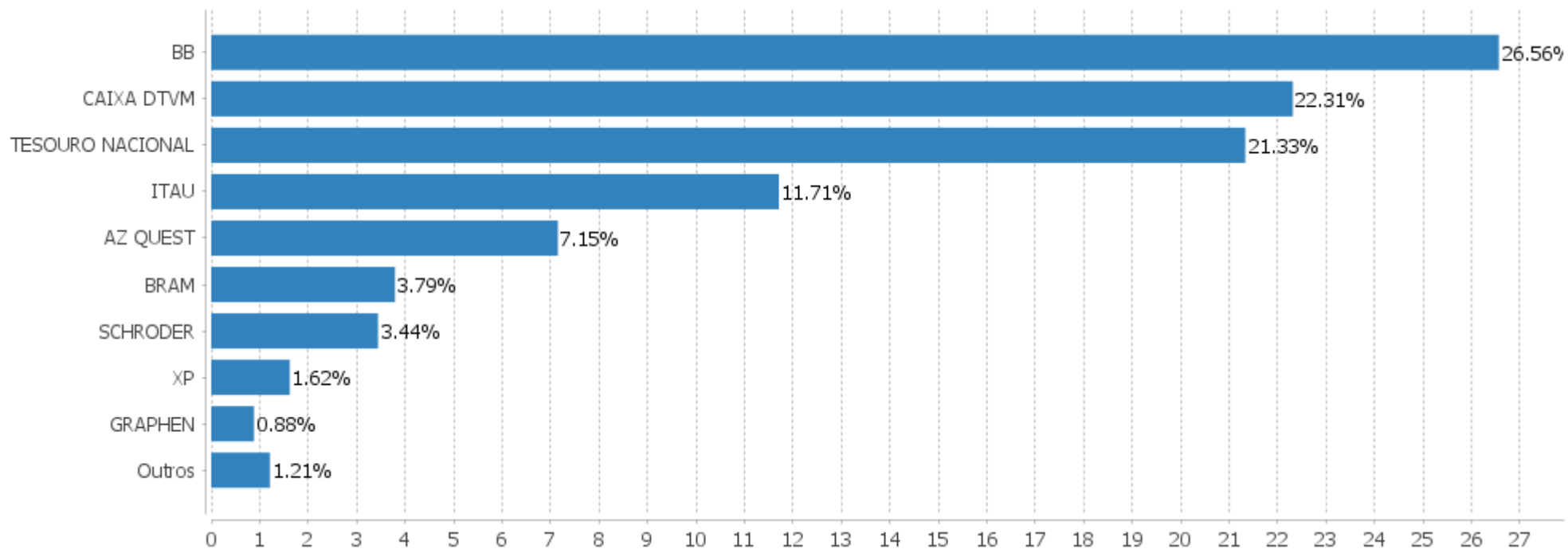


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,33	0,06											-0,26
IPCA + 4,84%	0,94	1,37											2,32
p.p. indexador	-1,26	-1,31											-2,58
2021	-0,37	-0,60	0,51	1,09	1,28	0,17	-0,77	-1,12	-0,53	-1,71	0,97	0,80	-0,33
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,04	-1,84	-0,90	0,36	0,01	-0,80	-2,19	-2,46	-2,14	-3,38	-0,40	-0,42	-16,32
2020	0,74	-0,95	-6,76	0,85	2,01	1,95	2,67	-0,62	-1,01	0,15	2,81	2,88	4,40
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	0,03	-1,61	-7,33	0,71	1,94	1,21	1,79	-1,34	-2,13	-1,19	1,46	1,02	-6,22
2019	2,83	0,10	0,40	1,16	1,59	2,44	1,21	0,05	1,70	1,87	-0,25	2,19	16,35
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,00	-0,79	-0,79	0,10	0,95	1,99	0,49	-0,57	1,25	1,24	-1,23	0,55	5,76

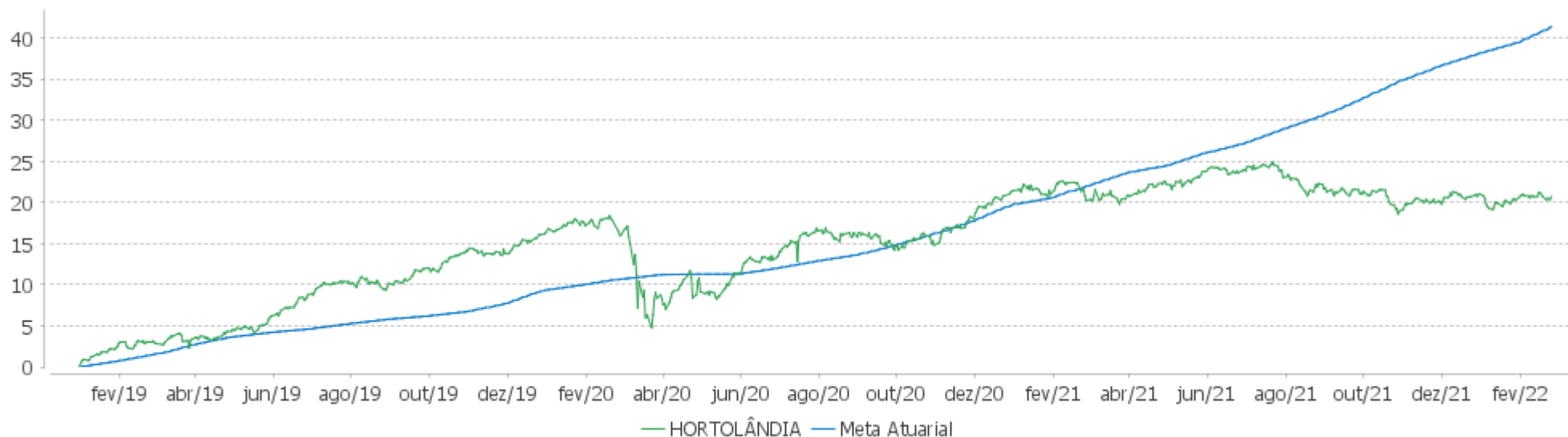
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

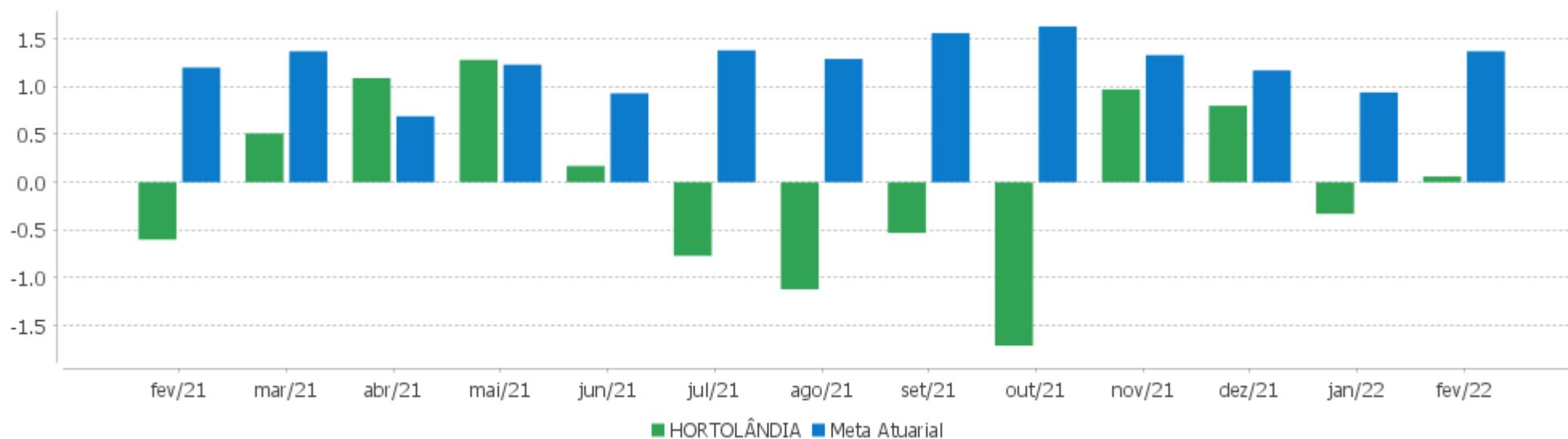
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	44,74	03 meses	0,53	3,56	-3,03	3,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	55,26	06 meses	-0,76	8,46	-9,21	3,75
			12 meses	0,38	16,45	-16,07	3,95
			24 meses	4,02	29,52	-25,50	7,57
Maior rentabilidade da Carteira	2,88	2020-12	36 meses	17,32	42,72	-25,41	6,57
Menor rentabilidade da Carteira	-6,76	2020-03	Desde 31/12/2018	20,76	45,20	-24,44	6,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,74 -0,01	1,36 -0,02	2,21 -0,05	2,84 -0,09	4,00 -0,26	6,81 -0,65	13,48 -1,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,81 -0,20	1,48 -0,08	2,32 0,02	2,92 -2,85	1,86 -8,68	6,59 -9,70	21,76 0,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,11	1,17 -0,14	1,89 -0,26	4,12 -0,19	6,30 -0,40	13,18 -0,93	24,90 -1,99
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,01	-0,24 -0,04	-0,04 -0,07	0,58 -0,15	0,65 -0,27	3,56 -0,56	21,95 -0,91
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,93 -0,08	1,46 -0,10	2,33 0,03	4,51 -1,26	5,85 -4,70	8,44 -7,85	18,85 -2,10
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,17 -0,37	-1,29 -1,09	-2,68 -2,71	-3,93 -4,66	-5,57 -6,50	-5,18 -9,30	17,08 -5,78
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,53	1,06 1,26	1,94 1,91	4,19 3,46	5,94 5,02	11,97 7,85	30,24 7,38
NTN-B 150545 (5,660001%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,11 0,57	2,26 2,45	3,55 3,52	5,62 4,89	10,50 9,58	15,62 11,50	20,23 -2,63
NTN-B 150840 (5,020001%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,07 0,52	2,16 2,35	3,40 3,37	8,28 7,55	13,14 12,22	18,10 13,98	22,53 -0,32
NTN-B 150535 (5,170000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,08 0,53	2,18 2,38	3,43 3,40	8,36 7,62	13,20 12,28	18,13 14,01	22,53 -0,33
FIDC PREMIUM % do CDI	-0,16 -21,94	-0,33 -22,32	-0,63 -27,75	-1,52 -39,94	-5,76 -102,02	-10,02 -122,95	-18,58 -130,92
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-97,09 -684,13
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-97,09 -684,13
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-97,09 -684,13
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	0,37 48,95	0,87 58,30	1,00 44,03	2,17 56,86	2,78 49,27	-3,91 -47,94	-4,74 -33,40
BRA1 FI RENDA FIXA	0,62	0,43	0,73	1,20	0,11	-20,97	-68,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07	0,62	0,70	0,47	-0,81	-25,08	-91,21
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,20 -0,34	1,09 1,28	-0,09 -0,12	-1,55 -2,28	-2,45 -3,37	-5,21 -9,33	2,76 -20,10
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	-15,62 -16,68	-15,91 -17,09	-15,84 -17,82	-15,36 -19,63	-49,72 -56,04	-49,08 -62,02	-59,21 -85,89
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 -2,36	1,13 -6,81	3,47 -7,55	-11,11 -6,36	-7,61 -10,43	-11,59 -20,20	28,08 9,71
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,21 -2,10	0,11 -7,82	1,09 -9,93	-13,89 -9,14	-7,48 -10,30	-3,23 -11,84	16,23 -2,14
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-1,44 3,75	2,47 4,42	6,46 4,69	-13,36 5,24	-4,34 8,98	-3,15 8,26	23,29 3,07
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,52 1,07	-16,04 -1,27	-14,66 -2,59	-9,04 -3,21	-3,64 -2,43		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,75 -11,21	-25,87 -28,37	-27,80 -31,59	-24,21 -33,06	-27,00 -44,21	44,06 13,46	
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,36 -1,82	-0,68 -3,18	-0,98 -4,78	-1,89 -10,74	143,09 125,88	-92,77 -123,37	-92,76 -136,71
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,05 -1,50	-0,11 -2,61	-0,21 -4,01	-0,55 -9,40	-1,16 -18,36	17,42 -13,18	-22,27 -66,21
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	-49,65 -879,20	-59,19 -726,04	-79,54 -560,46
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-1,10 -147,17	-1,52 -102,48	-1,95 -86,38	-3,18 -83,47	-5,56 -98,36	-9,30 -114,01	-4,36 -30,71
BRCR11 Var. IBOVESPA p.p.	-2,46 -3,35	-3,97 -11,91	10,09 -0,93	-7,89 -3,14	-14,72 -17,54	-27,65 -36,26	-12,38 -30,75
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII Var. IFIX p.p.	-0,93 0,36	-1,80 0,46	-2,00 -8,31	-1,58 -1,26	-42,75 -37,71	-42,91 -35,40	-50,84 -63,43
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII % do CDI	-3,95 -527,56	-6,41 -431,02	-1,19 -52,76	-10,99 -288,44	-6,75 -119,59	-22,52 -276,21	-89,50 -630,69
HORTOLÂNDIA Var. IPCA + 4,84% p.p.	0,06 -1,31	-0,26 -2,58	0,53 -2,98	-0,76 -9,02	0,38 -15,53	4,02 -23,75	17,32 -21,97
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRA1 FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1440	D+1445		1,30
BRAPRECO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se aplica	Não se aplica				
BRCR11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII	Não se aplica	Não se aplica				
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5	D+0	D+0	D+30 ou D+1800 (isento de taxa de resgate)	D+31 ou D+1801 (isento de taxa de resgate)		0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIDC PREMIUM	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN3	Não se aplica	Não se aplica				
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN4	Não se aplica	Não se aplica				
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS	Não se aplica	Não se aplica				
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		1,90
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C / VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					ÚTIL DE DEZEMBRO E JUNHO.	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0			-	
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII	Não se aplica	Não se aplica				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
8	01/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	540.000,00	0,00	191.717,51084200	2,8166441220
15	02/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	50.000,00	17.742,17350900	2,8181440100
9	07/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	180.000,00	0,00	63.733,79949800	2,8242471250
14	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	20.000.000,00	7.921.924,67913234	2,5246390000
16	09/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	80.000,00	28.340,13381800	2,8228518790
19	10/02/2022	NTN-B 150545 (5,660001%)	19.996.116,03	0,00	4.956,00000000	4.034,7288190000
10	10/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	5.080.000,00	0,00	1.799.594,07187000	2,8228588210
17	10/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	567.900,00	0,00	201.179,03019900	2,8228588210
11	18/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.300.000,00	0,00	812.741,03304000	2,8299297150
12	24/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	4.310.000,00	1.520.730,32391400	2,8341645670
18	24/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	35.283,76621600	2,8341645670
13	25/02/2022	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	580.000,00	0,00	204.583,84358900	2,8350234790
Total			29.244.016,03	24.540.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 11.741.113,91

Value-At-Risk: 1,81%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HORTOLÂNDIA		1,81	1,81			648.340.282,76	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,02%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824		1,55	0,05	1,07			35.387.823,14	5,46
NTN-B 150545		3,96	0,05	1,93			14.899.829,26	2,30
NTN-B 150535 (5,170000%)		0,09	0,00	2,13			20.311.189,05	3,13
NTN-B 150545 (5,660001%)		0,22	0,00	2,13			20.143.235,84	3,11
NTN-B 150840 (5,020001%)		0,09	0,00	2,13			47.543.709,22	7,33
Sub-total	1,51	0,78	0,11		0,15	0,98	138.285.786,51	21,33

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI		0,57	0,02	0,02			52.461.509,81	8,09
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,14	0,15	0,02			71.149.297,13	10,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,12	0,25			82.623.812,18	12,74
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI		0,59	0,02	0,61			50.011.662,86	7,71
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,12	0,06	2,02			48.598.224,03	7,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,75	0,04	0,78			62.003.215,71	9,56
Sub-total	1,81	1,13	0,40		0,04	0,82	366.847.721,72	56,58

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRA1 FI RENDA FIXA		0,90	0,00	1,72			398.920,88	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI RF MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5		2,45	-0,00	2,82			508.162,13	0,08
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA		0,98	-0,00	2,41			3.633.303,42	0,56
Sub-total	7,37	0,83	-0,00		-0,35	-1,82	4.540.386,43	0,70

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC		0,08	0,00	0,09			1.836.722,63	0,28
FIDC PREMIUM		0,06	-0,00	0,07			1.662.148,95	0,26
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 4		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 3		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	0,77	0,03	0,00		-0,83	0,11	3.498.871,58	0,54

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,64%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS		13,38	0,44	4,88			24.550.279,52	3,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,83	0,55	5,78			46.384.408,47	7,15
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,62	0,30	5,21			25.905.500,92	4,00
Sub-total	13,79	9,64	1,28		-0,16	-1,39	96.840.188,91	14,94

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,22%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,90	0,03	14,88			10.470.992,34	1,62
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		9,12	-0,02	9,24			22.334.633,95	3,44
Sub-total	30,70	10,22	0,02		-0,25	-6,91	32.805.626,29	5,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,53%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO RIO BRAVO RENDA VAREJO - FII		0,65	-0,00	0,65			1.884.000,00	0,29
BRCR11		3,02	-0,00	9,97			223.454,64	0,03
ÁQUILLA FI IMOBILIÁRIO - FII		0,09	-0,00	3,50			1.163.477,74	0,18
Sub-total	12,77	0,53	-0,00		-0,28	-2,79	3.270.932,38	0,50

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V		0,04	-0,00	0,06			215.867,90	0,03
Sub-total	2,52	0,04	-0,00		-0,74	-1,10	215.867,90	0,03

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA		0,07	-0,00	0,12			525.771,70	0,08
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS		-0,00	0,00	-0,04			-276,97	-0,00
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP		0,02	-0,00	0,09			1.509.406,31	0,23
Sub-total	0,47	0,03	-0,00		-1,86	-0,13	2.034.901,04	0,31